

农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证
券投资基金
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：农银汇理基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 08 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 3 月 21 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	50
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	54
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§ 12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金	
基金简称	农银瑞云增益 6 个月持有混合	
基金主代码	017624	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 3 月 21 日	
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	271,316,038.48 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	农银瑞云增益 6 个月持有混合 A	农银瑞云增益 6 个月持有混合 C
下属分级基金的交易代码	017624	017625
报告期末下属分级基金的份额总额	198,020,602.59 份	73,295,435.89 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具，辅助投资于精选的股票，力争控制基金的回撤水平，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金运用自上而下的宏观分析和自下而上的市场分析相结合的方法实现大类资产配置，把握不同的经济周期各类资产的投资机会，根据基本面、社会融资水平、通胀、货币政策等因素，预测固收类资产（包括债券、可转债、可交债等）、权益类、现金管理类大类资产的预期收益率水平，结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，进行大类资产配置。综合运用高等级信用策略、久期配置策略、期限结构策略、量化选股策略、资产支持证券投资策略等策略，力争实现基金资产的稳健增值。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*15%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		农银汇理基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	翟爱东	张姗
	联系电话	021-61095588	0755-83077987
	电子邮箱	xuxin@abc-ca.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		021-61095599	95555

传真	021-61095556	0755-83195201
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	黄涛	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.abc-ca.com
基金中期报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	农银汇理基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年 3 月 21 日（基金合同生效日）-2023 年 6 月 30 日	
	农银瑞云增益 6 个月持有混合 A	农银瑞云增益 6 个月持有混合 C
本期已实现收益	1,277,468.56	391,299.36
本期利润	1,622,722.12	518,995.84
加权平均基金份额本期利润	0.0082	0.0071
本期加权平均净值利润率	0.82%	0.71%
本期基金份额净值增长率	0.82%	0.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	1,278,010.20	391,391.42
期末可供分配基金份额利润	0.0065	0.0053

期末基金资产净值	199,643,981.92	73,814,573.76
期末基金份额净值	1.0082	1.0071
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	0.82%	0.71%

注：1、本基金的基金合同于 2023 年 3 月 21 日生效，至 2023 年 06 月 30 日不满半年。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 6 月 30 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

农银瑞云增益 6 个月持有混合 A

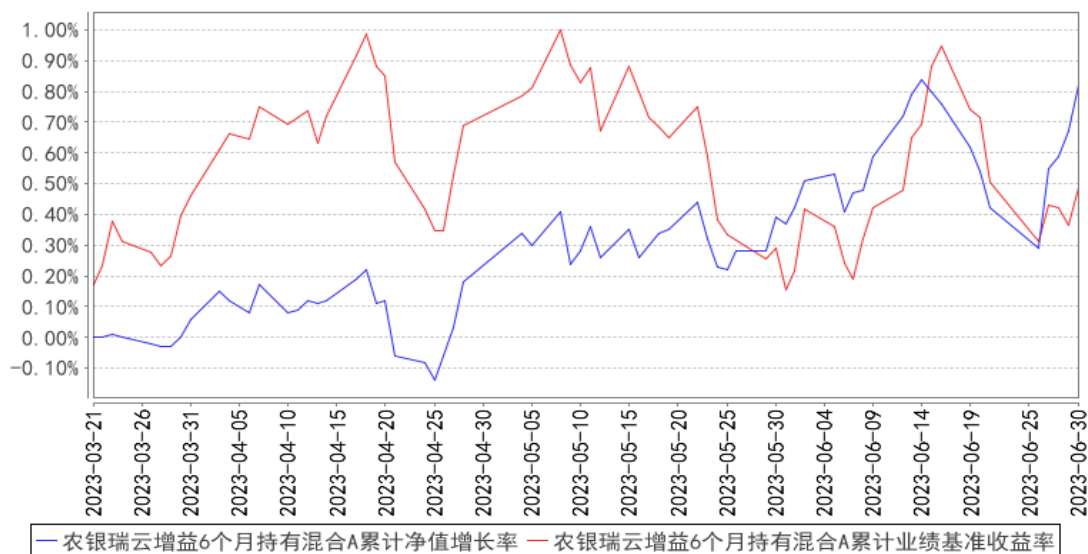
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.45%	0.11%	0.33%	0.13%	0.12%	-0.02%
过去三个月	0.76%	0.09%	0.03%	0.12%	0.73%	-0.03%
自基金合同生效起至今	0.82%	0.09%	0.49%	0.12%	0.33%	-0.03%

农银瑞云增益 6 个月持有混合 C

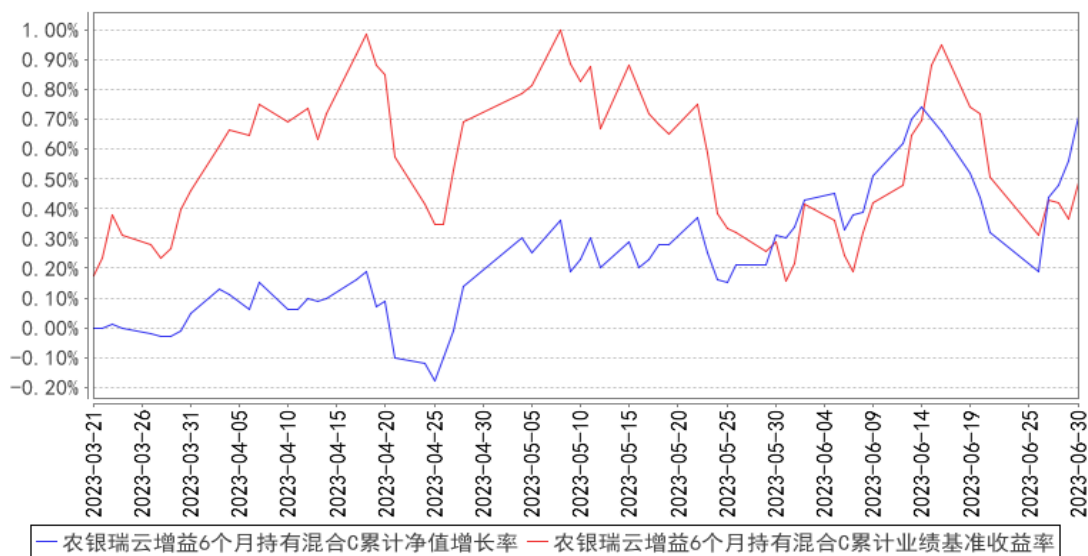
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.41%	0.10%	0.33%	0.13%	0.08%	-0.03%
过去三个月	0.66%	0.09%	0.03%	0.12%	0.63%	-0.03%
自基金合同生效起至今	0.71%	0.08%	0.49%	0.12%	0.22%	-0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

农银瑞云增益6个月持有混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



农银瑞云增益6个月持有混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板及其他经中国证监会核准，注册发行的股票），国债，金融债，地方政府债，公司债，企业债，可转换债券，可交换债券，央行票据，中期票据，短期融资券，超短期融资券，债券回购，资产支持证券，同业存单，银行存款（包括协议存款，定期存款及其他银行存款），货币市场工具，股指期货，国债期货，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票，可交换债券和可转换债券（不含分离交易可转债的纯

债部分)资产的比例合计占基金资产的 10%-30%, 同业存单的投资占基金资产的比例合计不超过 20%。每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%, 其中现金不包括结算备付金, 存出保证金, 应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制, 基金管理人在履行适当程序后, 可以调整上述投资品种的投资比例。本基金建仓期为基金合同生效日(2023 年 3 月 21 日)起 6 个月, 截至报告期末, 建仓期未满足。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

农银汇理基金管理有限公司成立于 2008 年 3 月 18 日, 是中法合资的有限责任公司。公司注册资本为人民币壹拾柒亿伍仟万零壹元, 其中中国农业银行股份有限公司出资比例为 51.67%, 东方汇理资产管理公司出资比例为 33.33%, 中铝资本控股有限公司出资比例为 15%。公司办公地址为中国(上海)自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。公司法定代表人为黄涛先生。

截止 2023 年 6 月 30 日, 公司共管理 75 只开放式基金, 分别为农银汇理行业成长混合型证券投资基金、农银汇理恒久增利债券型证券投资基金、农银汇理平衡双利混合型证券投资基金、农银汇理策略价值混合型证券投资基金、农银汇理中小盘混合型证券投资基金、农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金、农银汇理货币市场证券投资基金、农银汇理沪深 300 指数证券投资基金、农银汇理增强收益债券型证券投资基金、农银汇理策略精选混合型证券投资基金、农银汇理中证 500 指数证券投资基金、农银汇理消费主题混合型证券投资基金、农银汇理行业轮动混合型证券投资基金、农银汇理金聚高等级债券型证券投资基金、农银汇理低估值高增长混合型证券投资基金、农银汇理行业领先混合型证券投资基金、农银汇理区间收益灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理研究精选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金汇债券型证券投资基金、农银汇理红利日结货币市场基金、农银汇理医疗保健主题股票型证券投资基金、农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金、农银汇理工业 4.0 灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理天天利货币市场基金、农银汇理现代农业加灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理新能源主题灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理国企改革灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金丰一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理金穗纯债 3 个月

定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理日日鑫交易型货币市场基金、农银汇理尖端科技灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理中国优势灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理研究驱动灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理量化智慧动力混合型证券投资基金、农银汇理金鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金禄债券型证券投资基金、农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金、农银汇理丰泽三年定期开放债券型证券投资基金、农银养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、农银汇理金盈债券型证券投资基金、农银汇理金益债券型证券投资基金、农银汇理丰盈三年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理彭博 1-3 年中国利率债指数证券投资基金、农银汇理金祺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理创新医疗混合型证券投资基金、农银汇理策略趋势混合型证券投资基金、农银汇理智增一年定期开放混合型证券投资基金、农银养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金、农银汇理金润一年定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理策略收益一年持有期混合型证券投资基金、农银汇理新兴消费股票型证券投资基金、农银汇理安瑞一年持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理金玉债券型证券投资基金、农银汇理金盛债券型证券投资基金、农银汇理瑞康 6 个月持有期混合型证券投资基金、农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金、农银汇理创新成长混合型证券投资基金、农银汇理悦利债券型证券投资基金、农银汇理均衡收益混合型证券投资基金、农银汇理金穗优选 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金、农银汇理金鸿短债债券型证券投资基金、农银汇理绿色能源精选混合型证券投资基金、农银汇理专精特新混合型证券投资基金、农银汇理双利回报债券型证券投资基金、农银汇理金耀 3 个月定期开放债券型证券投资基金、农银汇理品质农业股票型证券投资基金、农银汇理瑞泽添利债券型证券投资基金、农银汇理鑫享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理景气优选混合型证券投资基金、农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金、农银汇理医疗精选股票型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
钱大千	本基金的基金经理	2023 年 3 月 21 日	-	12 年	上海交通大学数学系博士。2010 年 12 月加入农银汇理基金管理有限公司，历任风险控制部风控专员、研究部研究员、农银汇理资产管理有限公司资产及财富管理部投资经理、农银汇理基金管理有限公司投资理财部投资经理。现任农银汇理双利

					回报债券型证券投资基金基金经理、农银汇理瑞泽添利债券型证券投资基金基金经理。
刘莎莎	本基金的基金经理	2023 年 3 月 21 日	-	14 年	香港科技大学经济学硕士。历任中诚信证券评估公司分析师、阳光保险资产管理中心信用研究员、泰康资产管理有限公司信用研究员、国投瑞银基金管理有限公司固定收益部总监助理兼基金经理。2019 年 7 月加入农银汇理基金管理有限公司，现任农银汇理基金管理有限公司固定收益部副总经理，农银汇理双利回报债券型证券投资基金基金经理、农银汇理瑞泽添利债券型证券投资基金基金经理。

注：1、任职、离任日期是指公司作出决定之日，基金成立时担任基金经理和经理助理的任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业是指《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》规定的从业情况，也包括在其他金融机构从事证券投资研究等业务。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产。报告期内，本基金未违反法律法规及基金合同的规定，也未出现对基金份额持有人利益造成不利影响的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规和公司内部公平交易制度的规定，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保旗下管理的所有投资组合得到公平对待。

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，通过对交易价差做专项分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易的现象。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

未发生本基金参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年海外来看，美国增长韧性较强，联储延续鹰派强调两次加息，美债回落，美元指数微升，汇率贬值逼近 7.3。国内经济下行斜率最快阶段或已过，5 月工业企业盈利降幅边际收窄，6 月 PMI 景气低位弱回升，疫后复苏的季节性规律和库存周期看，下半年经济环比企稳概率较大。国常会要求采取更加有力的措施，增强发展动能，央行重提要加大逆周期调节力度，组合拳有望陆续出台。从高频数据来看，信心下行仍制约消费，地产销售仍在趋势性转冷，投资和生产处于淡季，积极信号是制造业开始回升。总体来看，一季度基本面低位反弹后，4、5 月单月数据走弱，近期环比企稳，稳增长信号增多，二季度央行货币政策报告重提逆周期调节，后续政策工具空间打开。

上半年债券市场先上后下，一季度信用利差下行，二季度信用利差维持低位，同时利率震荡下行。股票市场在经历一月份的修复后震荡下行，价值、成长风格快速轮动，核心资产调整幅度较大。

产品 3 月 21 日成立，债券主要为信用债，利率债以 10% 左右仓位波段操作。4-5 月建仓完成后，组合杠杆维持 130%。其中，权益仓位在建仓初期为 5% 左右，市场波动过程中，择机加仓后维持在 10% 中枢。产品整体波动率较低，市场波动过程中回撤较小。实现了低波动，稳健收益的投资目标。

股票组合在季度初风格略偏价值，一季报后我们增加了部分绩优成长板块配置，如汽车零部件、电力设备、医药等，当前风格较为均衡。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末农银瑞云增益 6 个月持有混合 A 基金份额净值为 1.0082 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.82%，同期业绩比较基准收益率为 0.49%；截至本报告期末农银瑞云增益 6 个月持有混合 C 基金份额净值为 1.0071 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.71%，同期业绩比较基准收益率为 0.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，逆周期政策的逐步落地背景下，仍需关注社融数据改善的持续性，就业及居民收入的变化，目前从高频数据来看，房地产的销售仍较为低迷，债券维持中性操作，但需要观察后续政策落实后基本面的变化情况。权益方面计划维持均衡的风格配置，积极寻找二季报中延续增长

趋势的行业和板块。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则》、于 2022 年 7 月 1 日颁布的《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14 号)、中国证券投资基金业协会于 2012 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉有关衔接事宜的通知》(证监会会计字[2007]15 号)、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(证监会公告[2017]13 号)、中国证券投资基金业协会于 2022 年 12 月 30 日发布的《关于固定收益品种的估值处理标准》等文件,本公司制订了证券投资基金估值政策和程序,并设立了估值委员会。

公司参与基金估值的机构及人员职责:公司估值委员会负责本公司估值政策和程序的制定和解释,并定期对估值政策和程序进行评价,在发生影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况、以及当本公司旗下的证券投资基金在采用新投资策略或投资新品种时,估值委员会应评价现有估值政策和程序的适用性,必要时及时进行修订。公司运营部根据相关基金《基金合同》、《招募说明书》等文件关于估值的约定及公司估值政策和程序进行日常估值。基金经理根据市场环境的变化,书面提示公司风险控制部和运营部测算投资品种潜在估值调整对基金资产净值的影响可能达到的程度。风险控制部提交测算结果给运营部,运营部参考测算结果对估值调整进行试算,并根据估值政策决定是否向估值委员会提议采用新的估值方法。公司监察稽核部对上述过程进行监督,根据法规进行披露。

以上参与估值流程各方为公司各部门人员,均具有基金从业资格,具有丰富的基金从业经验和相关专业胜任能力,且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理的代表作为公司估值委员会委员,可以提议测算某一投资品种的估值调整影响,并有权投票表决有关议案。基金经理有影响具体证券估值的利益需求,但是公司的制度和组织结构约束和限制了其影响程度,如估值委员会表决时,其仅有一票表决权,遵守少数服从多数的原则。

本公司未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的要求,报告期内本基金不需分配利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定。报告期内,本基金未出现上述情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	1,017,080.66
结算备付金		2,299,543.63
存出保证金		14,906.46
交易性金融资产	6.4.7.2	360,454,806.08
其中：股票投资		29,992,937.58
基金投资		-
债券投资		330,461,868.50
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-
债权投资	6.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	6.4.7.6	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-
应收清算款		58,337.01
应收股利		-
应收申购款		389.00
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		363,845,062.84
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		90,023,435.35
应付清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		156,887.13
应付托管费		44,824.91
应付销售服务费		24,205.34
应付投资顾问费		-
应交税费		18,012.31
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	119,142.12
负债合计		90,386,507.16
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	271,316,038.48
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	2,142,517.20
净资产合计		273,458,555.68
负债和净资产总计		363,845,062.84

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 271,316,038.48 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.0082 元，基金份额总额 198,020,602.59 份；下属 C 类基金份额净值 1.0071 元，基金份额总额 73,295,435.89 份。

6.2 利润表

会计主体：农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023年3月21日（基金合同生效日）至2023年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年3月21日（基金合同生效日）至2023年6月30日
一、营业总收入		3,183,580.49
1. 利息收入		447,612.81
其中：存款利息收入	6.4.7.13	25,359.01
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		422,253.80
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,263,017.64
其中：股票投资收益	6.4.7.14	198,243.63
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	1,738,953.26
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	325,820.75
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	472,950.04
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-
减：二、营业总支出		1,041,862.53
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	526,697.73
2. 托管费	6.4.10.2.2	150,485.10
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	81,282.07
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		225,264.43
其中：卖出回购金融资产支出		225,264.43
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		3,587.64
8. 其他费用	6.4.7.23	54,545.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,141,717.96

减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,141,717.96
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		2,141,717.96

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理瑞云增益6个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023年3月21日（基金合同生效日）至2023年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年3月21日（基金合同生效日）至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	271,168,185.01	-	-	271,168,185.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	147,853.47	-	2,142,517.20	2,290,370.67
（一）、综合收益总额	-	-	2,141,717.96	2,141,717.96
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	147,853.47	-	799.24	148,652.71
其中：1. 基金申购款	147,853.47	-	799.24	148,652.71
2. 基金赎回款	-	-	-	-
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合	-	-	-	-

收益结转留存收益				
四、本期期末净资产(基金净值)	271,316,038.48	-	2,142,517.20	273,458,555.68

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>程昆</u>	<u>毕宏燕</u>	<u>丁煜琼</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)按照国家相关法律、法规、农银汇理[2022]169 号《关于农银汇理中债 5-10 年农发行债券指数证券投资基金变更注册为农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金的请示》和经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]3062 号《关于准予农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金注册的批复》核准,由农银汇理基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 271,078,959.63 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0157 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2023 年 3 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 271,168,185.01 份基金份额,其中认购资金利息折合 89,225.38 份基金份额。本基金的基金管理人为农银汇理基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》和《农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据销售费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认/申购基金时收取认购/申购费,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费,并不收取认购费/申购费的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存,并分别计算基金份额净值。

据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发

行上市的股票(包括创业板及其他经中国证监会核准、注册发行的股票)、国债、金融债、地方政府债、公司债、企业债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货、国债期货,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。基金的投资组合比例为:本基金投资于股票、可交换债券和可转换债券(不含分离交易可转债的纯债部分)资产的比例合计占基金资产的 10%-30%,同业存单的投资占基金资产的比例合计不超过 20%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中债综合全价(总值)指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*15%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 03 月 21 日(基金合同生效日)至 2023 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2023 年 3 月 21 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金

成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产

支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、

财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	1,017,080.66
等于：本金	1,016,701.27
加：应计利息	379.39
减：坏账准备	-

定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,017,080.66

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	30,159,772.40	-	29,992,937.58	-166,834.82	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	147,978,556.48	1,822,340.20	149,831,571.00	30,674.32
	银行间市场	178,356,889.46	1,664,297.50	180,630,297.50	609,110.54
	合计	326,335,445.94	3,486,637.70	330,461,868.50	639,784.86
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	356,495,218.34	3,486,637.70	360,454,806.08	472,950.04	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期买入返售金融资产期末余额中无资产减值准备。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末无债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末无其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	67,428.12
其中：交易所市场	65,185.62
银行间市场	2,242.50
应付利息	-
预提费用	51,714.00
合计	119,142.12

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

农银瑞云增益 6 个月持有混合 A

项目	本期 2023 年 3 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	197,909,008.87	197,909,008.87
本期申购	111,593.72	111,593.72
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	198,020,602.59	198,020,602.59

农银瑞云增益 6 个月持有混合 C

项目	本期 2023 年 3 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	73,259,176.14	73,259,176.14
本期申购	36,259.75	36,259.75
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	73,295,435.89	73,295,435.89

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

农银瑞云增益 6 个月持有混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,277,468.56	345,253.56	1,622,722.12
本期基金份额交易产生的变动数	541.64	115.57	657.21
其中：基金申购款	541.64	115.57	657.21
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,278,010.20	345,369.13	1,623,379.33

农银瑞云增益 6 个月持有混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	391,299.36	127,696.48	518,995.84
本期基金份额交易产生的变动数	92.06	49.97	142.03
其中：基金申购款	92.06	49.97	142.03
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	391,391.42	127,746.45	519,137.87

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	11,459.26
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	13,859.24
其他	40.51
合计	25,359.01

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	38,623,112.08
减：卖出股票成本总额	38,299,508.72
减：交易费用	125,359.73
买卖股票差价收入	198,243.63

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年3月21日（基金合同生效日）至2023年6月 30日
债券投资收益——利息收入	1,682,440.71
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	56,512.55
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-

合计	1,738,953.26
----	--------------

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年3月21日（基金合同生效日）至2023年6 月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,981,536.94
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,864,632.83
减：应计利息总额	56,546.35
减：交易费用	3,845.21
买卖债券差价收入	56,512.55

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年3月21日（基金合同生效日）至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	325,820.75
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	325,820.75

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年3月21日（基金合同生效日）至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	472,950.04
股票投资	-166,834.82
债券投资	639,784.86
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	472,950.04

6.4.7.21 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 3 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	19,615.62
信息披露费	32,098.38
证券出借违约金	-
银行费用	2,831.56
合计	54,545.56

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

报告期内对本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
农银汇理基金管理有限公司（以下简称“农银汇理”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（以下简称“农业银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 3 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	526,697.73
其中：支付销售机构的客户维护费	258,793.49

注：支付基金管理人农银汇理的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.7% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.7% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 3 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	150,485.10

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.2% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023 年 3 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	农银瑞云增益 6 个月持有混合 A	农银瑞云增益 6 个月持有混合 C	合计
农银汇理	-	0.52	0.52
农业银行	-	66,092.69	66,092.69
招商银行	-	11,763.47	11,763.47

合计	-	77,856.68	77,856.68
----	---	-----------	-----------

注：C 级基金份额支付的销售服务费按前一日 C 级基金资产净值×0.4%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$C \text{ 级基金日销售服务费} = \text{前一日 C 级基金基金资产净值} \times 0.4\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期无转融通证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期无转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 3 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	1,017,080.66	11,459.26

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2023 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601916	浙商银行	2023 年 6 月 27 日	1 个月内(含)	增发流通受限	2.02	2.64	8,370	16,907.40	22,096.80	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 90,023,435.35 元，于 2023 年 07 月 03 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人的风险政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。通过事前制定科学合理的制度和业务流程、事中有效的执行和管控、事后全面的检查和改进，将风险管理贯穿于基金投资运作的整个环节，有效防范和化解基金面临的市场风险、信用风险、流动性风险及投资合规性风

险。

本基金管理人建立了“三层架构、三道防线”的风险管理组织体系。董事会及其下设的稽核及风险控制委员会是公司风险管理的最高层次，负责建立健全公司全面风险管理体系，审核公司基本风险管理制度、风险偏好、重大风险政策，对风险管理承担最终责任。公司管理层及其下设的风险管理委员会组成风险管理的第二层次，根据董事会要求具体组织和实施公司风险管理工作，对风险管理承担直接责任。第一层次由各个部门组成，承担业务风险的直接管理责任。公司建立了层次明晰、权责统一、监管明确的三道内部控制防线，实现了业务经营部门、风险管理部门、审计部门的分工协作，前、中、后台的相互制约，以及对公司决策层、管理层、操作层的全面监督和控制。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，导致基金资产损失的可能性。

本基金管理人建立了内部评级体系、存款银行名单和交易对手库，对投资债券进行内部评级，对存款银行、交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	67,270,042.54
合计	67,270,042.54

注：未评级的债券投资一般包括国债、央行票据、政策性银行金融债、超短期融资券和同业存单。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日
AAA	152,326,461.30
AAA 以下	-
未评级	110,865,364.66
合计	263,191,825.96

注：未评级的债券投资一般包括国债、央行票据、政策性银行金融债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因市场交易相对不活跃导致基金投资资产无法以适当价格及时变现，进而无法对投资者赎回款或基金其它应付款按时支付的风险。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，本基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理措施，控制因开放模式而产生的流动性风险。本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，因此除附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

本报告期内，本基金管理人通过独立的风险管理部门对本基金投资品种变现指标、持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、以及组合在短时间内变现能力的综合指标等进行持续的监测和分析，同时定期统计本基金投资者结构、申购赎回特征，进行压力测试，分析本基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配程度。

截止本报告期末及上年度末，本基金流动性风险可控。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，主要包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人日常通过对持仓品种组合的久期分析等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	1,017,080.66	-	-	-	1,017,080.66
结算备付金	2,299,543.63	-	-	-	2,299,543.63
存出保证金	14,906.46	-	-	-	14,906.46
交易性金融资产	123,945,312.77	177,683,243.40	28,833,312.33	29,992,937.58	360,454,806.08
应收申购款	-	-	-	389.00	389.00
应收清算款	-	-	-	58,337.01	58,337.01
资产总计	127,276,843.52	177,683,243.40	28,833,312.33	30,051,663.59	363,845,062.84
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	156,887.13	156,887.13
应付托管费	-	-	-	44,824.91	44,824.91
卖出回购金融资产款	90,023,435.35	-	-	-	90,023,435.35
应付销售服务费	-	-	-	24,205.34	24,205.34
应交税费	-	-	-	18,012.31	18,012.31
其他负债	-	-	-	119,142.12	119,142.12
负债总计	90,023,435.35	-	-	363,071.81	90,386,507.16
利率敏感度缺口	37,253,408.17	177,683,243.40	28,833,312.33	29,688,591.78	273,458,555.68

注：按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	收益率曲线平行变化	
	忽略债券组合凸性变化对基金资产净值的影响	
	其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2023年6月30日）
	市场利率平行上升 25 个基点	-2,088,550.68
市场利率平行下降 25 个基点	2,088,550.68	

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监测，定期对基金所面临的价格风险进行度量和分析，及时对风险进行管理和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	29,992,937.58	10.97
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	29,992,937.58	10.97

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金采用历史数据拟合回归方法来进行其他价格风险敏感性分析。为保证该方法所得结果的参考价值，一般需要至少 1 年的基金净值数据。截至本报告期末，本基金的运营期小于 1 年，无足够的经验数据进行分析，因此不披露本报告期末其他价格风险敏感性分析。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	56,304,689.69
第二层次	304,128,019.59
第三层次	22,096.80
合计	360,454,806.08

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2022 年 12 月 31 日：同）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	29,992,937.58	8.24
	其中：股票	29,992,937.58	8.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	330,461,868.50	90.82
	其中：债券	330,461,868.50	90.82

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,316,624.29	0.91
8	其他各项资产	73,632.47	0.02
9	合计	363,845,062.84	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,648,256.00	0.60
C	制造业	18,628,559.68	6.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	581,946.00	0.21
E	建筑业	1,847,990.00	0.68
F	批发和零售业	140,160.00	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	421,716.00	0.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,447,663.50	0.90
J	金融业	2,513,851.80	0.92
K	房地产业	973,083.00	0.36
L	租赁和商务服务业	143,524.60	0.05
M	科学研究和技术服务业	353,055.00	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	137,312.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	155,820.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	29,992,937.58	10.97

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600489	中金黄金	70,800	731,364.00	0.27
2	601318	中国平安	12,700	589,280.00	0.22
3	601336	新华保险	10,800	397,116.00	0.15
4	000002	万 科 A	28,200	395,364.00	0.14
5	000801	四川九洲	51,600	376,680.00	0.14
6	000521	长虹美菱	49,100	375,124.00	0.14
7	603801	志邦家居	11,200	369,824.00	0.14
8	000338	潍柴动力	27,600	343,896.00	0.13
9	603518	锦泓集团	30,100	341,635.00	0.12
10	600582	天地科技	58,500	341,055.00	0.12
11	002060	粤 水 电	48,500	319,130.00	0.12
12	301039	中集车辆	24,000	317,520.00	0.12
13	601601	中国太保	11,900	309,162.00	0.11
14	600938	中国海油	17,000	308,040.00	0.11
15	300185	通裕重工	107,400	299,646.00	0.11
16	000048	京基智农	14,500	283,040.00	0.10
17	002478	常宝股份	34,600	257,770.00	0.09
18	000937	冀中能源	37,600	239,888.00	0.09
19	003031	中瓷电子	1,800	239,616.00	0.09
20	300750	宁德时代	1,000	228,790.00	0.08
21	601728	中国电信	39,100	220,133.00	0.08
22	603799	华友钴业	4,700	215,777.00	0.08
23	600268	国电南自	28,600	214,214.00	0.08
24	600741	华域汽车	11,400	210,444.00	0.08
25	600498	烽火通信	10,300	209,811.00	0.08
26	600875	东方电气	11,000	205,150.00	0.08
27	002605	姚记科技	4,400	204,292.00	0.07
28	000957	中通客车	19,000	200,640.00	0.07
29	300129	泰胜风能	20,700	198,513.00	0.07
30	000552	甘肃能化	59,600	198,468.00	0.07
31	601618	中国中冶	49,900	198,103.00	0.07
32	600587	新华医疗	5,600	197,848.00	0.07
33	600820	隧道股份	32,900	197,729.00	0.07
34	601377	兴业证券	32,300	197,676.00	0.07
35	603156	养元饮品	8,000	197,600.00	0.07
36	600284	浦东建设	32,200	197,064.00	0.07
37	000717	中南股份	70,500	195,990.00	0.07
38	002576	通达动力	9,800	195,902.00	0.07
39	002673	西部证券	30,800	195,580.00	0.07
40	000728	国元证券	29,800	194,296.00	0.07
41	600970	中材国际	15,200	193,800.00	0.07
42	600528	中铁工业	19,500	192,660.00	0.07

43	600986	浙文互联	30,100	192,640.00	0.07
44	603126	中材节能	24,700	191,178.00	0.07
45	601333	广深铁路	48,000	190,080.00	0.07
46	601128	常熟银行	27,800	189,596.00	0.07
47	600513	联环药业	19,600	189,336.00	0.07
48	600267	海正药业	16,400	186,632.00	0.07
49	600502	安徽建工	34,800	183,744.00	0.07
50	605100	华丰股份	10,300	181,589.00	0.07
51	300532	今天国际	8,800	180,928.00	0.07
52	002367	康力电梯	19,500	178,035.00	0.07
53	002270	华明装备	16,200	177,390.00	0.06
54	601890	亚星锚链	15,300	177,174.00	0.06
55	300473	德尔股份	9,800	176,988.00	0.06
56	603877	太平鸟	7,000	176,960.00	0.06
57	002997	瑞鹄模具	5,900	175,407.00	0.06
58	000921	海信家电	6,500	175,175.00	0.06
59	002454	松芝股份	20,600	174,482.00	0.06
60	300856	科思股份	2,200	173,294.00	0.06
61	603757	大元泵业	5,800	173,072.00	0.06
62	300745	欣锐科技	3,900	172,263.00	0.06
63	002912	中新赛克	3,900	171,639.00	0.06
64	002394	联发股份	20,100	171,051.00	0.06
65	300349	金卡智能	12,300	170,724.00	0.06
66	600985	淮北矿业	14,800	170,496.00	0.06
67	600736	苏州高新	33,600	170,352.00	0.06
68	002381	双箭股份	22,000	169,840.00	0.06
69	600066	宇通客车	11,500	169,510.00	0.06
70	002929	润建股份	3,900	169,299.00	0.06
71	603238	诺邦股份	13,400	168,974.00	0.06
72	688569	铁科轨道	4,000	168,280.00	0.06
73	300756	金马游乐	8,800	168,256.00	0.06
74	600612	老凤祥	2,400	167,712.00	0.06
75	000599	青岛双星	39,200	167,384.00	0.06
76	300926	博俊科技	7,320	167,188.80	0.06
77	002959	小熊电器	2,000	167,000.00	0.06
78	002732	燕塘乳业	7,700	166,474.00	0.06
79	600211	西藏药业	2,800	166,320.00	0.06
80	003003	天元股份	15,700	166,106.00	0.06
81	300881	盛德鑫泰	5,040	166,068.00	0.06
82	000030	富奥股份	32,900	165,816.00	0.06
83	002533	金杯电工	20,300	165,648.00	0.06
84	002809	红墙股份	15,300	165,240.00	0.06
85	600894	广日股份	21,900	164,907.00	0.06

86	002345	潮宏基	20,900	164,274.00	0.06
87	601956	东贝集团	27,700	163,984.00	0.06
88	000560	我爱我家	61,800	163,770.00	0.06
89	603700	宁水集团	11,200	163,744.00	0.06
90	000153	丰原药业	16,200	163,620.00	0.06
91	600197	伊力特	6,000	163,020.00	0.06
92	300314	戴维医疗	7,700	162,778.00	0.06
93	002156	通富微电	7,200	162,720.00	0.06
94	600681	百川能源	34,800	162,516.00	0.06
95	003007	直真科技	6,300	162,477.00	0.06
96	002233	塔牌集团	20,900	161,348.00	0.06
97	603697	有友食品	17,580	161,208.60	0.06
98	603536	惠发食品	25,000	161,000.00	0.06
99	000850	华茂股份	43,100	159,901.00	0.06
100	600512	腾达建设	59,100	158,388.00	0.06
101	301087	可孚医疗	3,200	157,760.00	0.06
102	688488	艾迪药业	12,800	157,696.00	0.06
103	688551	科威尔	2,400	157,392.00	0.06
104	000533	顺钠股份	37,000	157,250.00	0.06
105	603878	武进不锈	18,500	156,325.00	0.06
106	002536	飞龙股份	10,400	156,000.00	0.06
107	688345	博力威	4,200	155,862.00	0.06
108	002422	科伦药业	5,200	154,336.00	0.06
109	688030	山石网科	7,200	154,296.00	0.06
110	300839	博汇股份	11,500	152,835.00	0.06
111	688225	亚信安全	7,200	150,840.00	0.06
112	688316	青云科技	3,000	148,950.00	0.05
113	002713	东易日盛	17,000	147,900.00	0.05
114	688505	复旦张江	17,100	147,573.00	0.05
115	688373	盟科药业	17,200	147,060.00	0.05
116	688004	博汇科技	4,200	146,874.00	0.05
117	301257	普蕊斯	2,600	146,120.00	0.05
118	002697	红旗连锁	24,000	140,160.00	0.05
119	301239	普瑞眼科	1,400	137,312.00	0.05
120	000951	中国重汽	8,100	136,485.00	0.05
121	688520	神州细胞	2,400	136,176.00	0.05
122	002572	索菲亚	7,700	134,134.00	0.05
123	603517	绝味食品	3,600	133,740.00	0.05
124	300896	爱美客	300	133,485.00	0.05
125	000928	中钢国际	13,500	130,275.00	0.05
126	601163	三角轮胎	8,200	130,134.00	0.05
127	000528	柳 工	16,100	127,190.00	0.05
128	000517	荣安地产	40,400	123,220.00	0.05

129	600170	上海建工	45,300	121,857.00	0.04
130	601686	友发集团	17,600	120,384.00	0.04
131	600639	浦东金桥	9,700	120,377.00	0.04
132	600132	重庆啤酒	1,300	119,808.00	0.04
133	000061	农产品	19,800	118,602.00	0.04
134	688676	金盘科技	3,900	118,131.00	0.04
135	600120	浙江东方	30,700	117,581.00	0.04
136	600642	申能股份	16,800	117,432.00	0.04
137	601003	柳钢股份	29,000	117,160.00	0.04
138	000783	长江证券	20,100	116,580.00	0.04
139	000685	中山公用	15,400	116,578.00	0.04
140	002557	洽洽食品	2,800	116,340.00	0.04
141	000828	东莞控股	12,700	116,205.00	0.04
142	601000	唐山港	32,700	115,431.00	0.04
143	600928	西安银行	31,600	111,232.00	0.04
144	600903	贵州燃气	12,800	110,720.00	0.04
145	603027	千禾味业	5,000	105,600.00	0.04
146	600750	江中药业	4,800	105,264.00	0.04
147	300842	帝科股份	1,100	100,584.00	0.04
148	601916	浙商银行	36,270	95,752.80	0.04
149	603589	口子窖	1,900	93,765.00	0.03
150	600305	恒顺醋业	8,300	90,138.00	0.03
151	600702	舍得酒业	700	86,765.00	0.03
152	603833	欧派家居	900	86,220.00	0.03
153	688045	必易微	1,500	85,500.00	0.03
154	000568	泸州老窖	400	83,828.00	0.03
155	000858	五粮液	500	81,785.00	0.03
156	688382	益方生物	5,800	79,402.00	0.03
157	600129	太极集团	1,300	77,337.00	0.03
158	002847	盐津铺子	900	76,545.00	0.03
159	002852	道道全	5,900	76,287.00	0.03
160	600863	内蒙华电	18,000	74,700.00	0.03
161	000333	美的集团	1,200	70,704.00	0.03
162	300770	新媒股份	1,500	68,790.00	0.03
163	300785	值得买	2,400	62,832.00	0.02
164	600757	长江传媒	7,300	62,780.00	0.02
165	300223	北京君正	700	61,817.00	0.02
166	603317	天味食品	4,220	61,654.20	0.02
167	600469	风神股份	9,500	61,180.00	0.02
168	603369	今世缘	1,100	58,080.00	0.02
169	300782	卓胜微	600	57,978.00	0.02
170	301191	菲菱科思	520	53,778.40	0.02
171	300502	新易盛	700	47,579.00	0.02

172	603345	安井食品	300	44,040.00	0.02
173	688580	伟思医疗	600	43,380.00	0.02
174	688109	品茗科技	1,575	40,792.50	0.01
175	600872	中炬高新	1,100	40,469.00	0.01
176	600941	中国移动	400	37,320.00	0.01
177	000665	湖北广电	6,200	34,844.00	0.01
178	601921	浙版传媒	3,600	31,284.00	0.01
179	002507	涪陵榨菜	1,690	30,943.90	0.01
180	688205	德科立	400	29,248.00	0.01
181	001330	博纳影业	2,900	26,912.00	0.01
182	600037	歌华有线	3,100	25,761.00	0.01
183	605168	三人行	290	24,922.60	0.01
184	600050	中国联通	4,300	20,640.00	0.01
185	300973	立高食品	300	20,526.00	0.01
186	600887	伊利股份	700	19,824.00	0.01
187	002624	完美世界	1,100	18,579.00	0.01
188	600809	山西汾酒	100	18,507.00	0.01
189	603288	海天味业	360	16,866.00	0.01
190	301297	富乐德	700	15,757.00	0.01
191	601360	三六零	1,100	13,794.00	0.01
192	002304	洋河股份	100	13,135.00	0.00
193	688639	华恒生物	145	13,119.60	0.00
194	600882	妙可蓝多	100	2,228.00	0.00
195	002425	凯撒文化	100	563.00	0.00
196	688660	电气风电	74	412.18	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600489	中金黄金	857,201.00	0.31
2	601336	新华保险	688,331.00	0.25
3	601318	中国平安	594,625.00	0.22
4	601601	中国太保	551,681.00	0.20
5	601728	中国电信	456,726.00	0.17
6	000048	京基智农	453,825.00	0.17
7	600502	安徽建工	422,611.00	0.15
8	600420	国药现代	410,931.00	0.15
9	000002	万科 A	408,336.00	0.15
10	000801	四川九洲	363,003.00	0.13
11	600970	中材国际	360,917.00	0.13
12	601333	广深铁路	359,423.00	0.13
13	000521	长虹美菱	358,210.00	0.13

14	603801	志邦家居	353,644.00	0.13
15	603197	保隆科技	353,559.00	0.13
16	000937	冀中能源	350,923.00	0.13
17	002233	塔牌集团	350,212.74	0.13
18	603338	浙江鼎力	348,366.00	0.13
19	600820	隧道股份	343,127.00	0.13
20	601699	潞安环能	341,992.00	0.13

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600420	国药现代	456,372.19	0.17
2	603197	保隆科技	390,695.00	0.14
3	601336	新华保险	388,124.00	0.14
4	002448	中原内配	363,584.00	0.13
5	601699	潞安环能	339,020.00	0.12
6	002798	帝欧家居	321,129.00	0.12
7	603338	浙江鼎力	320,198.00	0.12
8	600901	江苏金租	299,632.00	0.11
9	300753	爱朋医疗	290,816.00	0.11
10	603444	吉比特	267,812.00	0.10
11	600971	恒源煤电	266,200.00	0.10
12	601601	中国太保	264,715.00	0.10
13	600469	风神股份	260,439.00	0.10
14	603345	安井食品	258,437.00	0.09
15	688365	光云科技	254,992.67	0.09
16	603767	中马传动	250,683.00	0.09
17	601333	广深铁路	241,594.00	0.09
18	002540	亚太科技	240,055.00	0.09
19	600928	西安银行	238,271.00	0.09
20	000729	燕京啤酒	237,165.00	0.09

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	68,459,281.12
卖出股票收入（成交）总额	38,623,112.08

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	20,319,537.54	7.43
2	央行票据	-	-
3	金融债券	73,685,927.94	26.95
	其中：政策性金融债	64,056,680.27	23.42
4	企业债券	103,178,184.55	37.73
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	53,926,031.68	19.72
7	可转债（可交换债）	26,333,848.91	9.63
8	同业存单	53,018,337.88	19.39
9	其他	-	-
10	合计	330,461,868.50	120.85

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	220208	22 国开 08	410,000	41,291,200.82	15.10
2	112317112	23 光大银行 CD112	400,000	39,263,150.60	14.36
3	200220	20 国开 20	200,000	22,765,479.45	8.33
4	188883	21 铁投 01	210,000	21,612,162.08	7.90
5	188790	21 电建 05	200,000	20,491,210.96	7.49

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	14,906.46
2	应收清算款	58,337.01
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	389.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	73,632.47

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110059	浦发转债	10,868,678.15	3.97
2	113042	上银转债	5,865,316.11	2.14
3	113056	重银转债	2,934,152.47	1.07
4	113052	兴业转债	2,542,826.71	0.93
5	113044	大秦转债	1,813,603.78	0.66
6	113055	成银转债	797,301.45	0.29
7	123107	温氏转债	679,474.51	0.25
8	110053	苏银转债	352,005.26	0.13
9	110075	南航转债	250,261.21	0.09
10	113021	中信转债	230,229.26	0.08

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
农银瑞云增益 6 个月持有混合 A	3,279	60,390.55	9,184,291.87	4.64	188,836,310.72	95.36
农银瑞云增益 6 个月持有混合 C	3,685	19,890.21	1,190,293.40	1.62	72,105,142.49	98.38
合计	6,964	38,959.80	10,374,585.27	3.82	260,941,453.21	96.18

注：本基金机构、个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	农银瑞云增益 6 个月持有混合 A	5,348.89	0.0027
	农银瑞云增益 6 个月持有混合 C	22,978.66	0.0314
	合计	28,327.55	0.0104

注：从业人员持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	农银瑞云增益 6 个月持有混合 A	0~10
	农银瑞云增益 6 个月持有混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	农银瑞云增益 6 个月持有混合 A	0

	农银瑞云增益 6 个月持有混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	农银瑞云增益 6 个月持有混合 A	农银瑞云增益 6 个月持有混合 C
基金合同生效日 (2023 年 3 月 21 日) 基金份额总额	197,909,008.87	73,259,176.14
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	111,593.72	36,259.75
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	198,020,602.59	73,295,435.89

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产的诉讼。本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未发生改聘会计师事务所的情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华创证券	2	35,548,621.75	33.20	25,997.31	33.20	-
长江证券	2	29,902,004.38	27.93	21,867.47	27.92	-
国金证券	2	26,067,136.71	24.35	19,063.29	24.34	-
东方证券	2	6,081,323.79	5.68	4,448.54	5.68	-
中信建投证券	2	5,472,330.99	5.11	4,002.14	5.11	-
天风证券	2	3,158,518.18	2.95	2,309.79	2.95	-
中信证券	2	417,918.00	0.39	305.60	0.39	-
招商证券	2	282,912.00	0.26	206.89	0.26	-
中泰证券	2	76,320.00	0.07	55.81	0.07	-
申万宏源证券	2	58,400.00	0.05	54.40	0.07	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准有：

- (1)、实力雄厚,注册资本不少于20亿元人民币。
- (2)、市场形象及财务状况良好。
- (3)、经营行为规范,内控制度健全,最近一年未因发生重大违规行为而受到国家监管部门的处罚。

(4)、内部管理规范、严格，具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。

(5)、研究实力较强，具有专门的研究机构和专职研究人员，能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

公司研究部、投资部、投资理财部分别提出租用交易席位的申请，集中交易室汇总后提交总经理办公会议研究决定。席位租用协议到期后，研究部、投资部、投资理财部应对席位所属券商进行综合评价。总经理办公会议根据综合评价，做出是否续租的决定。

2、本基金本报告期新增以上交易单元，无剔除交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
华创证券	83,092,496.32	51.30	1,363,200,000.00	39.86	-	-
长江证券	14,131,181.00	8.72	225,014,000.00	6.58	-	-
国金证券	2,445,584.41	1.51	473,200,000.00	13.84	-	-
东方证券	35,745,934.15	22.07	535,500,000.00	15.66	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	15,890,450.36	9.81	183,200,000.00	5.36	-	-
中信证券	2,712,860.90	1.67	441,380,000.00	12.90	-	-
招商证券	7,961,047.37	4.91	56,000,000.00	1.64	-	-
中泰证券	-	-	102,800,000.00	3.01	-	-
申万宏源证券	-	-	40,000,000.00	1.17	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国泰君	-	-	-	-	-	-

安证券					
-----	--	--	--	--	--

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金份额发售公告	证券时报、基金管理人网站	2023 年 2 月 21 日
2	农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金招募说明书	证券时报、基金管理人网站	2023 年 2 月 21 日
3	农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金托管协议	证券时报、基金管理人网站	2023 年 2 月 21 日
4	农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同	证券时报、基金管理人网站	2023 年 2 月 21 日
5	农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要	证券时报、基金管理人网站	2023 年 2 月 21 日
6	农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、基金管理人网站	2023 年 3 月 22 日
7	农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金开放日常申购、转换、定期定额投资业务公告	证券时报、基金管理人网站	2023 年 4 月 21 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册本基金募集的文件；
- 2、《农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照复印件；
- 6、本报告期内公开披露的临时公告。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的住所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

农银汇理基金管理有限公司

2023 年 8 月 25 日